

Fecha de Publicación: 1 de marzo de 2013

Fecha de Información: 27 de febrero de 2013 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1202,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	311,7	143,6	52,0	188,7	0,6	32,0	91,0
15-35	347,0	437,6	298,0	54,3	3,6	156,7	136,0
36-60	19,4	6,5	0,0	0,0	6,5	19,4	0,0
61-90	75,8	50,9	0,0	20,0	13,8	18,7	37,1
91-180	8,3	35,1	10,0	0,5	25,1	7,9	0,0
>180	6,5	24,3	5,0	0,0	19,3	6,5	0,0
Total	768,7	698,0	365,0	263,4	68,9	241,2	264,1

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,7 %	0,2 %	1,9 %	2,2 %
15-35	3,4 %	3,2 %	3,1 %	3,2 %
36-60	-	3,9 %	3,1 %	3,3 %
61-90	2,5 %	3,3 %	3,0 %	2,8 %
91-180	-	3,1 %	2,6 %	3,0 %
>180	-	3,1 %	2,5 %	2,9 %
Total	3,4 %	3,0 %	2,6 %	2,9 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	25 de feb. al 1 de marzo				4 al 8 de marzo				11 al 15 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	119	4111	3799	2	127	3073	3116	13	113	2012	2733
Intragrupa y off-shore***	0	0	2122	1509	0	0	1840	920	0	0	1823	782
Otros	119	9	695	1619	127	2	484	1360	113	13	646	965
Total	128	128	6927	6927	129	129	5397	5397	126	126	4480	4480

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.